

# Indikationen für Swaps und Optionen

(21.05.2012, 16:01)



Swaps	EUR		USD		GBP		JPY		CHF						
	30/360 p.a.		30/360 s.a.		Act/365 s.a.		Act/365 s.a.		30/360 p.a.						
1 Jahr	0.982	-	0.992	0.55	-	0.60	1.31	-	1.36	0.32	-	0.37	0.08	-	0.13
2 Jahre	0.983	-	0.993	0.62	-	0.67	1.27	-	1.32	0.33	-	0.38	0.09	-	0.14
3 Jahre	1.072	-	1.082	0.72	-	0.77	1.30	-	1.35	0.34	-	0.39	0.15	-	0.20
4 Jahre	1.205	-	1.215	0.88	-	0.93	1.37	-	1.42	0.36	-	0.41	0.24	-	0.29
5 Jahre	1.360	-	1.370	1.06	-	1.11	1.48	-	1.53	0.41	-	0.46	0.35	-	0.40
7 Jahre	1.658	-	1.668	1.43	-	1.48	1.76	-	1.81	0.56	-	0.61	0.62	-	0.67
10 Jahre	1.973	-	1.983	1.83	-	1.88	2.21	-	2.26	0.85	-	0.90	0.93	-	0.98

  

EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	0.96-0.97	0.98-0.99	1.03-1.04	1.12-1.13	1.43-1.44	1.81-1.82	2.18-2.19	2.46-2.47	3M-Euribor	0.682
3 Jahre	1.06-1.07	1.09-1.10	1.16-1.17	1.28-1.29	1.62-1.63	1.99-2.00	2.30-2.31	2.54-2.55	6M-Euribor	0.969
4 Jahre	1.21-1.22	1.24-1.25	1.32-1.33	1.46-1.47	1.80-1.81	2.13-2.14	2.40-2.41	2.60-2.61	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.37-1.38	1.41-1.42	1.48-1.49	1.63-1.64	1.94-1.95	2.24-2.25	2.48-2.49	2.66-2.67	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.67-1.68	1.71-1.72	1.77-1.78	1.90-1.91	2.16-2.17	2.40-2.41	2.60-2.61	2.75-2.76	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.98-1.99	2.02-2.03	2.07-2.08	2.17-2.18	2.38-2.39	2.57-2.58	2.72-2.73	2.81-2.82	6M-USD	0.7364

  

EUR Swaptions	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	FX-Märkte	
2 Jahre	12-12	19-21	28-30	42-44	73-77	102-109	123-132	134-144	1Eur=USD	1.2743
3 Jahre	18-19	31-33	45-48	67-72	115-122	154-165	182-196	196-213	1Eur=GBP	0.8065
4 Jahre	26-27	46-49	66-70	99-106	160-171	206-221	239-258	257-280	1Eur=CHF	1.2011
5 Jahre	34-36	61-65	90-96	132-142	205-219	257-278	295-320	317-346	100CHF=Eur	83.257
7 Jahre	50-54	90-97	135-144	196-211	288-310	352-382	399-435	429-470	1Eur=JPY	101.14
10 Jahre	79-85	140-151	202-218	290-313	406-441	487-530	543-594	582-640	100JPY=Eur	0.9887

  

EUR Caps/Floors	2.50%	3.00%	3.50%	4.00%	4.50%	3.00%	2.75%	2.50%	2.25%	2.00%
2 Jahre	3-4	2-3	1-2	1-1	1-1	307-308	270-271	234-234	197-198	161-162
3 Jahre	16-19	11-14	8-10	6-8	5-6	490-493	431-433	371-374	313-316	256-259
4 Jahre	46-52	34-39	26-31	20-24	16-20	650-655	569-575	489-495	411-418	336-342
5 Jahre	95-106	72-83	56-66	45-54	36-44	786-796	687-697	589-600	494-505	403-414
7 Jahre	242-264	188-210	148-171	120-141	98-118	1010-1032	878-901	751-774	630-651	514-535
10 Jahre	514-557	407-453	326-372	266-311	219-263	1294-1340	1123-1168	960-1003	805-846	660-698